

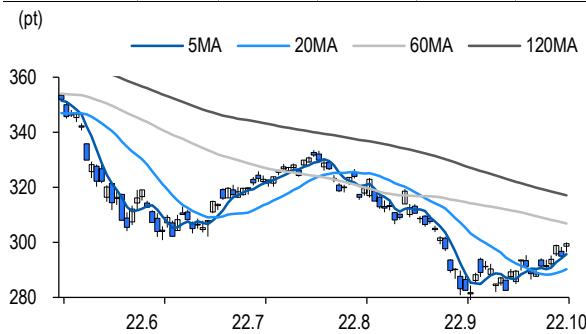


선물옵션시장 지표

2022.11.1

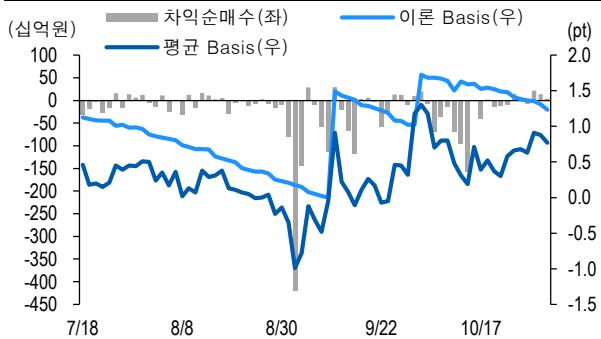
Market Data (십억원, 계약)

	종가(pt)	등락률(%)	등락폭(pt)	거래대금	미결제
KOSPI200	299.58	1.53	4.52	6,378.0	-
선물 12월물	300.70	1.66	4.90	22,340.2	337,474
선물 3월물	298.50	1.72	5.05	45.5	19,417
11월물(mini)	300.20	1.68	4.96	1,436.7	77,530
12월물(mini)	300.60	1.62	4.98	8.7	6,786



차익거래 관련 Market data (pt)

	이론값	평균값	현재가	괴리율(%)
K200 베이시스	1.24	0.77	1.12	-0.16%
베이시스(mini)	0.33	0.25	0.62	-0.03%
제1스프레드(SP)	-1.92	-2.29	-2.25	-0.12%
합성선물 베이시스(ATM)	0.33	0.67	0.67	0.12%



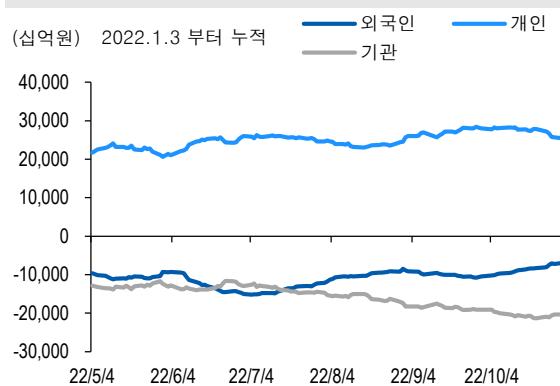
투자주체별 매매 동향

(십억원)

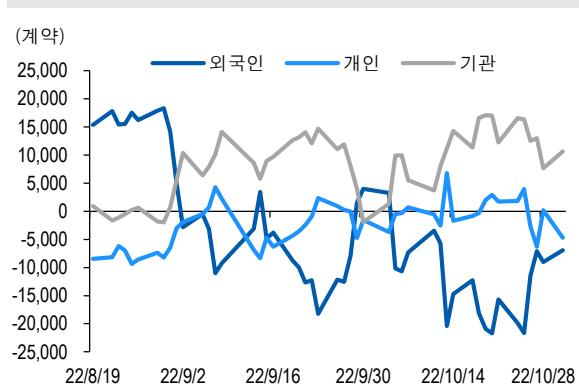
	KOSPI	ETF 전체	KOSPI+ETF	차익 PR	비차익 PR	K200F	K200F(mini)	콜옵션	풋옵션	주식선물전체
외국인	230.6	12.9	243.5	2.8	134.2	83.5	74.0	-3.6	-2.1	-18.0
개인	-205.6	-60.7	-266.3	0.0	0.0	-306.4	-60.4	5.1	-1.9	-20.0
기관	-27.9	49.8	22.0	1.4	-24.6	236.8	-10.4	-2.0	4.5	37.8
금융투자	-10.5	111.6	101.0	1.4	-0.6	-240.3	-10.6	-2.0	1.7	-3.2
투신	5.8	-8.8	-3.0	0.0	-4.9	432.9	0.3	0.1	-0.1	40.0
은행+보험+기타금융	24.7	-15.5	9.2	0.0	28.9	49.2	-0.1	-0.1	2.8	0.5
연기금+국가지자체	-44.5	-1.5	-46.0	-0.1	-47.7	-4.9	0.0	0.0	0.0	0.6
기타법인	2.9	-2.1	0.8	0.0	-0.2	-13.9	-3.2	0.5	-0.4	0.2

자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

투자주체별 KOSPI + ETF 전체 누적 순매수 추이



투자주체별 선물 누적 순매수 추이



자료: KRX, 유안타증권 리서치센터

선물옵션시장 지표

지수옵션 시장동향

								(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	대표변동성		거래량	거래대금	미결제약정			
Call	922,183	298.9	1,116,101	20.4%	지수옵션 전체		1,910,504	514.2	2,826,419		
Put	988,321	215.2	1,710,318	21.9%	PCR(금액기준)		0.72	VKOSPI	21.97%(-0.74%p)		
Call	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	302.5(K+3)	3.10	1.35	70,701	29,132	1,813	20.4	297.5(K+1)	3.08	-2.74	19,368
	300.0(K+2)	4.33	1.76	57,363	32,387	6,585	21.0	295.0(K+0)	2.25	-2.36	48,441
	297.5(K+1)	5.81	2.17	21,651	16,689	272	21.7	292.5(K-1)	1.65	-1.92	61,650
	295.0(K+0)	7.50	2.65	8,909	16,948	1	22.5	290.0(K-2)	1.17	-1.56	75,492
	292.5(K-1)	9.35	3.03	882	14,156	-133	23.1	287.5(K-3)	0.82	-1.28	84,443
Put	행사가	종가	등락(pt)	거래량	미결제약정	미결제증감	내재변동성	행사가	종가	등락(pt)	거래량
	297.5(K+1)	3.08	-2.74	19,368	7,491	2,170	20.3	295.0(K+0)	2.25	-2.36	48,441
	295.0(K+0)	2.25	-2.36	48,441	14,732	2,614	20.8	292.5(K-1)	1.65	-1.92	61,650
	292.5(K-1)	1.65	-1.92	61,650	14,569	246	21.5	290.0(K-2)	1.17	-1.56	75,492
	290.0(K-2)	1.17	-1.56	75,492	20,999	2,607	22.0	287.5(K-3)	0.82	-1.28	84,443
	287.5(K-3)	0.82	-1.28	84,443	20,638	2,208	22.6				

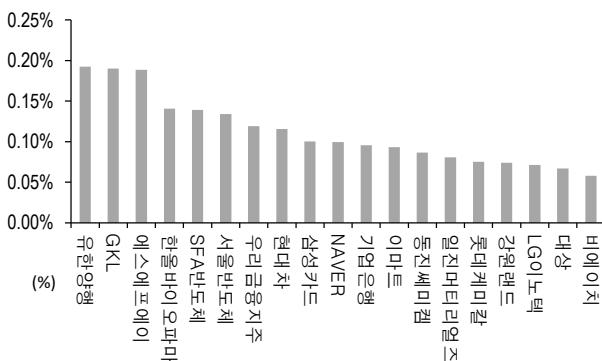
자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

역시적 변동성과 VKOSPI



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물 평균베이시스 괴리율



자료: KRX, 유인타증권 리서치센터

주식선물시장 동향(선현배율 상위 10종목)

										(계약, 십억원)			
	거래량	거래대금	미결제약정	미결제증감	외국인(계약)	개인(계약)	기관(계약)	외국인(금액)	개인(금액)	기관(금액)	금융투자	연기금등	순매수
주식선물 전체	3,936,327	2,599.8	4,826,298	50,859	-54,827	-4,245	59,293	-18.0	-20.0	37.8			
종목명	선물현재가(원)	등락률(%)	선물거래대금(십억원)	선현배율(%)	미결제수량(계약)	미결제증감(계약)	평균괴리율(%)	외국인순매수	개인순매수	기관순매수	금융투자순매수	연기금등순매수	
삼성전자	59,500	3.48	848.4	75.6	1,251,869	37,344	-0.03%	22,593	-39,759	18,911	-16,503	-145	
삼성전기	120,500	2.55	41.0	69.5	36,877	147	-0.02%	894	-241	-813	422	-414	
현대차	164,000	-0.30	69.4	69.0	43,971	-3,322	0.12%	-4,659	662	3,994	3,930	64	
넥센타이어	7,720	0.13	0.6	68.0	3,346	-462	-0.19%	-704	796	-92	-92	0	
코스맥스	45,950	0.00	0.9	60.5	2,286	80	-0.35%	250	19	-269	-273	0	
CJ제일제당	411,500	-0.36	9.3	57.8	3,269	749	-0.60%	-190	165	25	784	0	
SK하이닉스	82,800	-0.96	291.5	56.1	189,389	-3,824	-0.02%	14,274	2,497	-16,477	-19,531	82	
한국조선해양	72,900	-0.27	4.5	55.1	4,633	11	-0.07%	-375	127	248	140	108	
대한항공	22,750	-1.73	16.0	54.6	94,742	4,111	-0.08%	-5,611	3,510	1,651	3,509	-1,858	
넷마블	44,850	2.28	3.7	53.8	10,959	-390	0.02%	445	236	-681	-735	54	

자료: KRX, 유인타증권 리서치센터